

RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

Multi-Assets

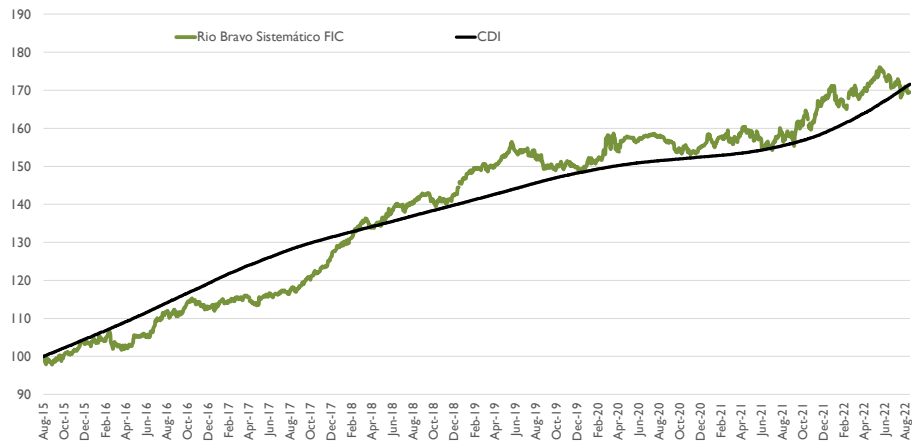


PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2022	Fundo	-1.41	0.21	1.37	1.86	1.97	-0.87	-0.55	-1.62	-	-	-	-	0.87
	CDI	0.73	0.76	0.93	0.83	1.03	1.02	1.03	1.17	-	-	-	-	7.75
	% CDI	-	27.7	-	222.7	-	-	-	-	-	-	-	-	11.2
2021	Fundo	-0.48	1.49	-0.12	1.49	-1.04	-1.28	1.01	0.79	1.84	1.45	0.88	1.64	7.87
	CDI	0.15	0.13	0.20	0.21	0.27	0.31	0.36	0.43	0.44	0.49	0.59	0.77	4.42
	% CDI	-322.7	1104.2	-61.8	-	-384.1	-416.9	284.3	-	-	-	-	213.8	177.9
2020	Fundo	0.98	0.52	3.58	-0.32	0.60	0.02	0.66	-0.65	-1.22	-0.34	-0.98	1.46	4.29
	CDI	0.38	0.29	0.34	0.28	0.24	0.21	0.19	0.16	0.16	0.16	0.15	0.16	2.76
	% CDI	259.6	175.9	1058.8	-113.5	254.6	-	-	-	-	-217.2	-	-	155.6
2019	Fundo	2.89	0.53	0.32	0.88	2.34	-0.46	-0.45	-0.46	-1.61	0.71	-0.33	-0.88	3.43
	CDI	0.54	0.49	0.47	0.52	0.54	0.47	0.57	0.50	0.46	0.48	0.38	0.37	5.96
	% CDI	532.6	107.6	68.4	-	430.3	-98.2	-	-90.9	-348.1	-	-87.2	-235.2	57.6
Anual		2015	2016	2017	2018									
	Fundo	3.64	9.61	12.41	13.12									
	CDI	5.06	14.00	9.93	6.42									
% CDI	71.92	68.62	125.03	204.35										

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	69.54	STRESS (% PL)	-3.92
CDI DESDE O INÍCIO (%)	71.65	VALOR DA COTA DO FUNDO	169.54
% CDI DESDE O INÍCIO	97.1	SHARPE DESDE O INÍCIO	-0.01
PL ATUAL	R\$ 11,675,859	SHARPE 12 MESES	-0.42
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 10,881,962	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MASTER ATUAL	R\$ 11,653,202	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.30	NÚMERO MESES POSITIVOS	61
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	6.72	NÚMERO MESES NEGATIVOS	24
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.40	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	27
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.61	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	45

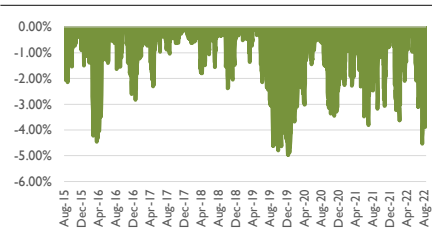
PERFORMANCE RELATIVA (%)



CORRELAÇÕES

	SISTEMATICO	IBOVESPA	S&P500	IHFA	IFIX	DOLAR	OURO
SISTEMATICO	1.0	-0.03	-0.05	-0.03	-0.11	0.1	-0.01
IBOVESPA	-0.03	1.0	0.58	0.75	0.46	-0.37	-0.3
S&P500	-0.05	0.58	1.0	0.54	0.3	-0.19	-0.16
IHFA	-0.03	0.75	0.54	1.0	0.47	-0.31	-0.2
IFIX	-0.11	0.46	0.3	0.47	1.0	-0.28	-0.1
DOLAR	0.1	-0.37	-0.19	-0.31	-0.28	1.0	0.36
OURO	-0.01	-0.3	-0.16	-0.2	-0.1	0.36	1.0

MAX DRAWDOWN



Recomendações ao investidor: Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. • Para avaliação do desempenho de fundo(s) de investimento(s), é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. • Este documento tem um caráter meramente informativo e não deve ser considerado como uma oferta de aquisição de cotas dos fundos de investimentos. • Performance passada não é garantia de ganhos futuros. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo fundo garantidor de crédito. • A rentabilidade não é líquida de impostos. • A Rio Bravo Investimentos S.A. não se responsabiliza por quaisquer decisões tomadas tendo como base os dados neste documento. • Todo o material aqui contido, incluindo os textos, gráficos, imagens e qualquer outro material de comunicação audiovisual são de propriedade única e exclusiva da Rio Bravo, bem como quaisquer informações, relatórios, produtos e serviços, que conjuntamente compõem valiosa propriedade intelectual da Rio Bravo. • O material aqui veiculado deve ser entendido como de uso pessoal. • Não é permitido qualquer tipo de transmissão, cópia ou adulteração sem o expresso escrito consentimento da Rio Bravo, sob pena de se tratar clara e infração aos direitos de propriedade da Rio Bravo, acarretando as devidas sanções legais. • As informações aqui contempladas não constituem qualquer tipo de oferta ou recomendação de investimento. • A Rio Bravo não é responsável por qualquer utilização não autorizada do material e das informações aqui dispostas.

Objetivo do Fundo
O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital, no longo prazo superior a rentabilidade dos Certificados de Depósito Interbancário - CDI.
A Política de Investimento consiste na alocação de parte dos seus recursos em renda variável, títulos públicos ou privados, cotas de fundos de investimentos e operações no mercado derivativo (inclusive operações vendidas) sem compromisso de limites de concentração de fator de risco.

Público-Alvo
Público em geral

Informações do Produto
Administrador • BEM DTVM Ltda. (Grupo Bradesco)
Gestor • Rio Bravo Investimentos Ltda.
Distribuidor • Rio Bravo DTVM
Custódia • Banco Bradesco S.A.
Controladoria • Banco Bradesco S.A.
Auditor • Pricewaterhousecoopers
Aplicação Inicial • R\$ 100.00
Saldo mínimo • R\$ 100.00
Movimentação mínima • R\$ 100.00
Aplicação • Conversão D+0 du
Resgate • Conversão D+15 Corridos
Liquidação Financeira • Primeiro dia útil subsequente à Data da Conversão
Taxa de Administração • 1,50% a.a.
Taxa de Performance • 20% a.a. excesso 100% CDI

Código ANBIMA • 402362

Classificação • Multimercado Livre

Perfil de Risco • Arrojado

Cota • Fechamento

Dados Bancários

Fav.: Rio Bravo Sistemático FIC FIM

- Banco Bradesco (237) - Ag. 2856 -

C/c 9738-1 - CNPJ 22.407.091/0001-17

Horário para Solicitação de Resgates e

Aplicações • 9h00 às 14h00

Imposto de Renda • Retido semestralmente

maio e novembro, alíquota de 15% e/ou

22,5% em aplicações até 180 dias.

20% em aplicações de 181 a 360 dias.

17,5% em aplicações de 361 a 720 dias.

15% em aplicações superiores a 720 dias.

IOF • Os resgates com prazo inferior a

30 (trinta) dias da data de aplicação

sofrerão tributação pelo IOF

